

Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

I) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG zum Gesamtbetrag (Angaben in Tsd. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten)	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	63.000	35.000	70.109	41.544	56.621	32.089	73.233	44.464
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	79.176	70.350	88.458	79.900	78.195	69.818	89.274	81.635
davon gattungsklassische Deckungswerte	74.176	65.350	83.445	74.874	73.191	64.800	84.264	76.609
davon sonstige Deckungswerte	5.000	5.000	5.012	5.026	5.004	5.018	5.011	5.026
Überdeckung in %	25,68%	101,00%	26,17%	92,33%	38,10%	117,57%	21,91%	83,60%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,15%					

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
bis einschließlich 6 Monate	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	5.000	0	0	0	5.000	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	5.000	0	0	0	5.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	1.536	0	0	0	1.536	0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	464	1.604	0	0	464	1.604
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.082	0	0	0	2.082	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	66.890	63.746	28.000	0	38.890	63.746
über 10 Jahre	3.204	0	35.000	35.000	-31.796	-35.000

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

Weitere Deckung	Nennwert		Anteil am Pfandbriefumlauf		Überschreitung gesetzlicher Grenzen	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%	0	0
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%		
1. Halbsatz (10,00%)					0	0
2. Halbsatz (2,00%)					0	0

Weitere Deckung nach Ländern und Art der gesetzlichen Begrenzung	§ 20 Abs. 2 Nr. 2 ohne § 4 Abs. 1 Satz 2 Nr. 1 u. 2 PfandBG		davon Forderungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	31.03.16	31.03.15
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	93,68%	92,89%

Keine Deckungswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen im Pfandbriefportfolio.

Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 und 2 PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

Deckungsmasse nach Größenklassen	31.03.16	31.03.15
bis einschließlich 10 Mio.€	25.593	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	53.583	-
mehr als 100 Mio.€	0	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	0	0	17.738	18.201	56.438	47.149	0	0
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	5.000	5.000

	31.03.16	31.03.15
darunter ECA-Finanzierungen	0	-

V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Tsd. Euro)

Rückständige Leistungen nach Ländern	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	0	0

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	0	-	0	-	0	-	0	-
Europäische Investitionsbank	0	-	0	-	0	-	0	-

Erläuterungen zu den im Report verwendeten Begriffen

Gattungsklassische Deckungswerte:	- Darlehnsforderungen oder Schuldverschreibungen nach § 20 Abs. 1 PfandBG
Sonstige Deckungswerte:	- weitere Deckungswerte nach § 20 Abs. 2 Nr. 1, § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG - sichernde Überdeckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG - Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG
Weitere Deckungswerte:	- nach § 20 Abs. 2 Nr. 1, § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG
Sichernde Überdeckung:	- nach § 4 Abs. 1 PfandBG